

АНОТАЦІЯ
вибіркової дисципліни
«Банківська аналітика та хеджування»

Мета вивчення навчальної дисципліни «Банківська аналітика та хеджування» є формування у здобувачів вищої освіти системи теоретичних знань і практичних навичок з аналізу банківської діяльності, оцінювання фінансових ризиків та застосування інструментів хеджування, а також розвитку управлінських компетенцій для прийняття ефективних рішень у сфері банківського менеджменту та забезпечення фінансової стабільності банку.

Очікувані результати навчання. За результатами вивчення навчальної дисципліни здобувачі вищої освіти повинні

знати:

- сутність, завдання та принципи банківської аналітики в системі фінансового менеджменту;
- методи збору, обробки та інтерпретації аналітичної інформації про діяльність банків;
- основи управління фінансовими ризиками та механізми їх хеджування;
- види, інструменти та стратегії хеджування в банківській практиці;
- сучасні методики оцінки ефективності фінансових операцій банку;
- принципи організації аналітичної роботи в банку та роль менеджменту в управлінні ризиками;
- нормативно-правову базу, що регулює аналітичну діяльність і хеджування в банківському секторі;
- міжнародні стандарти фінансової аналітики та ризик-менеджменту.

вміти:

- здійснювати комплексний фінансовий аналіз діяльності банківських установ;
- ідентифікувати, оцінювати та прогнозувати банківські ризики з використанням сучасних методів аналітики;
- розробляти та впроваджувати стратегії хеджування фінансових ризиків;

- приймати управлінські рішення на основі результатів банківського аналізу та оцінки ефективності операцій;
 - використовувати інструменти фінансового менеджменту для забезпечення стабільності та конкурентоспроможності банку;
 - застосовувати аналітичні методи для оптимізації структури активів і пасивів банку;
 - користуватися сучасними інформаційними системами та програмним забезпеченням для аналітики й управління ризиками;
- забезпечувати дотримання етичних норм, фінансової прозорості та професійної доброчесності в аналітичній діяльності.

Зміст програмного матеріалу:

Тема 1. Сутність, завдання та роль банківської аналітики в системі фінансового менеджменту

Тема 2. Методики фінансового аналізу діяльності банківських установ

Тема 3. Аналіз ризиків у банківській діяльності: види, ідентифікація, оцінка та контроль

Тема 4. Інструменти та механізми хеджування фінансових ризиків

Тема 5. Стратегії хеджування в банківському менеджменті: підходи, ефективність, обмеження

Тема 6. Роль менеджменту у забезпеченні фінансової безпеки банку через аналітичні механізми

Тема 7. Використання сучасних цифрових технологій і програмних систем у банківській аналітиці

Тема 8. Міжнародний досвід аналітики та хеджування у банківській сфері: порівняльний аналіз і практичні висновки

Обсяг (у кредитах ЄКТС/годинах) – 3 кредити / 90 годин

Форма контролю – залік

Кафедра, що забезпечує викладання навчальної дисципліни – менеджменту та економічної безпеки